

# 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 29 日

## 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成月月盈短期理财债券		
基金主代码	090023		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 9 月 12 日		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	22,856,155,851.14 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	大成月月盈 短期理财债券 A	大成月月盈 短期理财债券 B	大成月月盈 短期理财债券 E
下属分级基金的交易代码	090023	091023	001516
报告期末下属分级基金的 份额总额	126,466,766.59 份	22,585,166,967.68 份	144,522,116.87 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以保持基金资产的安全性和适当流动性为首要目标，追求高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金通过平均剩余期限决策、类属配置、品种选择和其他衍生工具投资策略四个层次进行投资管理，以实现超越投资基准的投资目标。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，及普通债券型证券投资基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵冰
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95566
传真	0755-83199588	010-66594942

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1 .1 期	报告期(2018 年 1 月 1 日- 2018 年 12 月 31 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日- 2017 年 12 月 31 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日- 2016 年 12 月 31 日)

间 数 据 和 指 标									
	大成月 月盈短 期理财 债券 A	大成月 月盈短 期理财 债券 B	大成月 月盈短 期理财 债券 E	大成月 月盈短 期理财 债券 A	大成月 月盈短 期理财 债券 B	大成月 月盈短 期理财 债券 E	大成月 月盈短 期理财 债券 A	大成月 月盈短 期理财 债券 B	大成月 月盈短 期理财 债券 E
本 期 已 实 现 收 益	9,600,3 99.77	1,036,5 57,955. 52	86,457, 086.57	5,328,9 29.49	341,101 ,394.97	77,073, 434.98	1,097,5 38.07	22,419, 308.72	1,236,8 73.70
本 期 利 润	9,600,3 99.77	1,036,5 57,955. 52	86,457, 086.57	5,328,9 29.49	341,101 ,394.97	77,073, 434.98	1,097,5 38.07	22,419, 308.72	1,236,8 73.70
本 期 净 值 收 益 率	3.8917%	4.1985%	3.8661%	4.2229%	4.5272%	4.2070%	2.8705%	3.1723%	2.8568%
3.1 .2	2018 年末			2017 年末			2016 年末		

期 末 数 据 和 指 标									
期 末 基 金 资 产 净 值	126,466 ,766.59	22,585, 166,967 .68	144,522 ,116.87	180,497 ,323.31	14,889, 242,261 .93	2,590,6 06,617. 67	23,866, 596.66	1,043,6 26,516. 80	218,315 ,814.32
期 末 基 金 份 额 净 值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金自 2014 年 9 月 12 日起由大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金,所涉及的相关累计数据计算起始日由原大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金成立日变更为大成月月盈短期理财债券证券投资基金合同生效日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成月月盈短期理财债券 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收 益率③	业绩比较 基准收 益率标准 差	①—③	②—④
----	--------------	---------------------	--------------------	--------------------------	-----	-----

				④		
过去三个	0.7629%	0.0009%	0.3403%	0.0000%	0.4226%	0.0009%
过去六个	1.6755%	0.0013%	0.6805%	0.0000%	0.9950%	0.0013%
过去一年	3.8917%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	2.5417%	0.0020%
过去三年	11.3213%	0.0032%	4.0500%	0.0000%	7.2713%	0.0032%
自基金合 同生效起 至今	18.3074%	0.0094%	5.8105%	0.0000%	12.4969%	0.0094%

## 大成月月盈短期理财债券 B

阶段	份额净值收 益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个	0.8415%	0.0009%	0.3403%	0.0000%	0.5012%	0.0009%
过去六个	1.8298%	0.0013%	0.6805%	0.0000%	1.1493%	0.0013%
过去一年	4.1985%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	2.8485%	0.0020%
过去三年	12.2945%	0.0032%	4.0500%	0.0000%	8.2445%	0.0032%
自基金合 同生效起 至今	19.7889%	0.0094%	5.8105%	0.0000%	13.9784%	0.0094%

## 大成月月盈短期理财债券 E

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个	0.7467%	0.0009%	0.3403%	0.0000%	0.4064%	0.0009%
过去六个	1.6541%	0.0013%	0.6805%	0.0000%	0.9736%	0.0013%
过去一年	3.8661%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	2.5161%	0.0020%
过去三年	11.3052%	0.0032%	4.0500%	0.0000%	7.2552%	0.0032%

自基金合同生效起至今	13.6902%	0.0055%	4.7749%	0.0000%	8.9153%	0.0055%
------------	----------	---------	---------	---------	---------	---------

注:1、本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

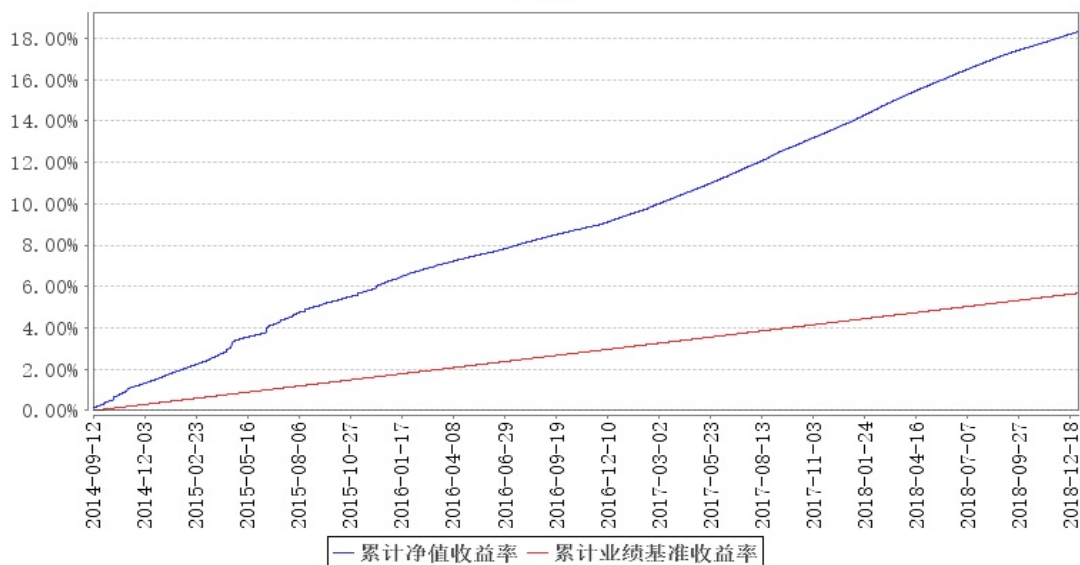
2、本表净值收益率的计算所采取的运作周期,是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

3、本基金自 2015 年 6 月 19 日起,新增 E 类份额。

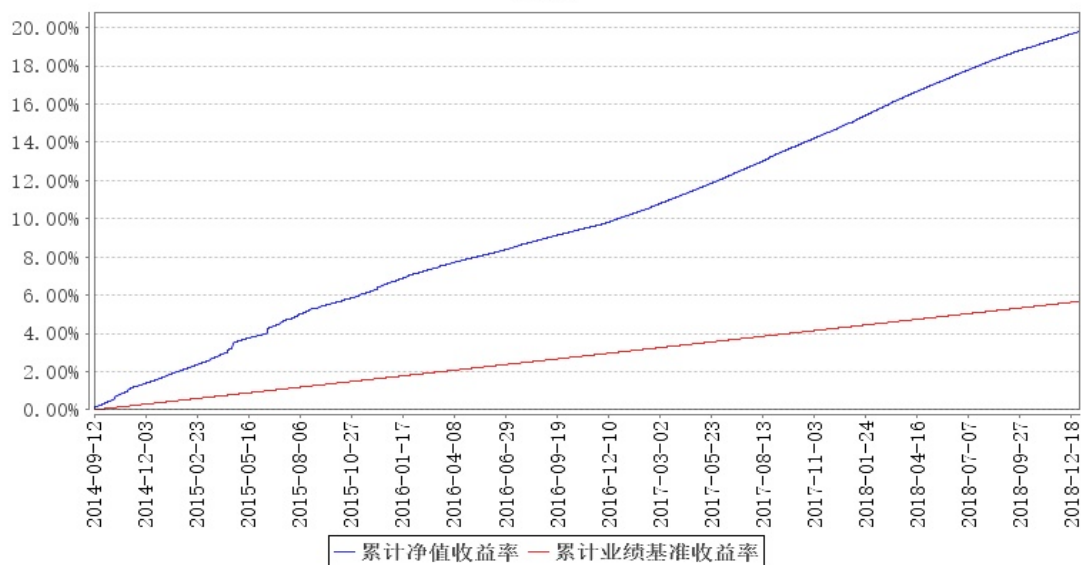
4、本基金自 2014 年 9 月 12 日起由大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金,所涉及的相关数据计算起始日从本次年报开始由原大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金成立日变更为大成月月盈短期理财债券证券投资基金合同生效日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

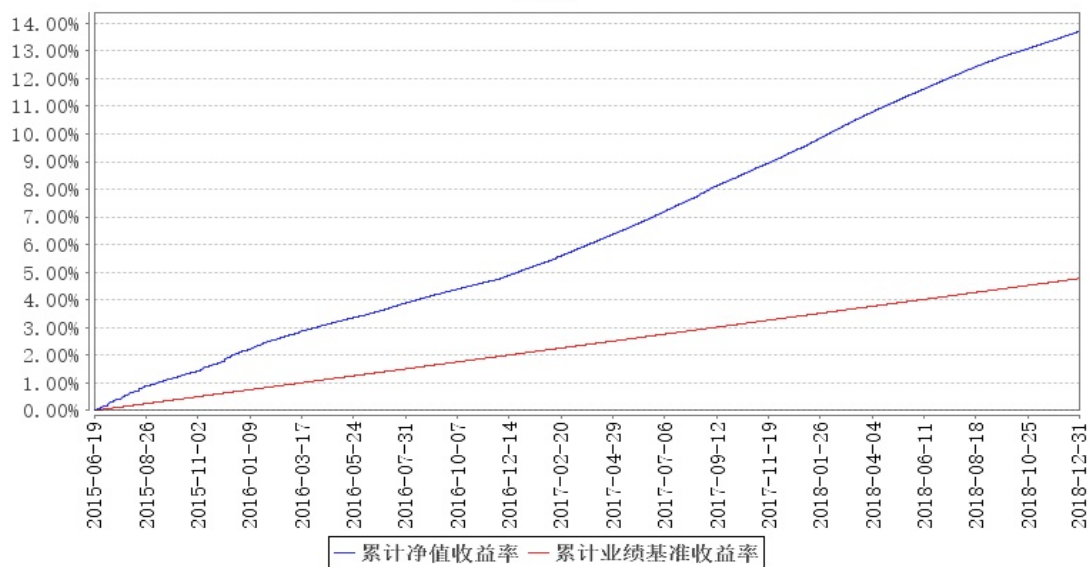
大成月月盈短期理财债券A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成月月盈短期理财债券B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成月月盈短期理财债券E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

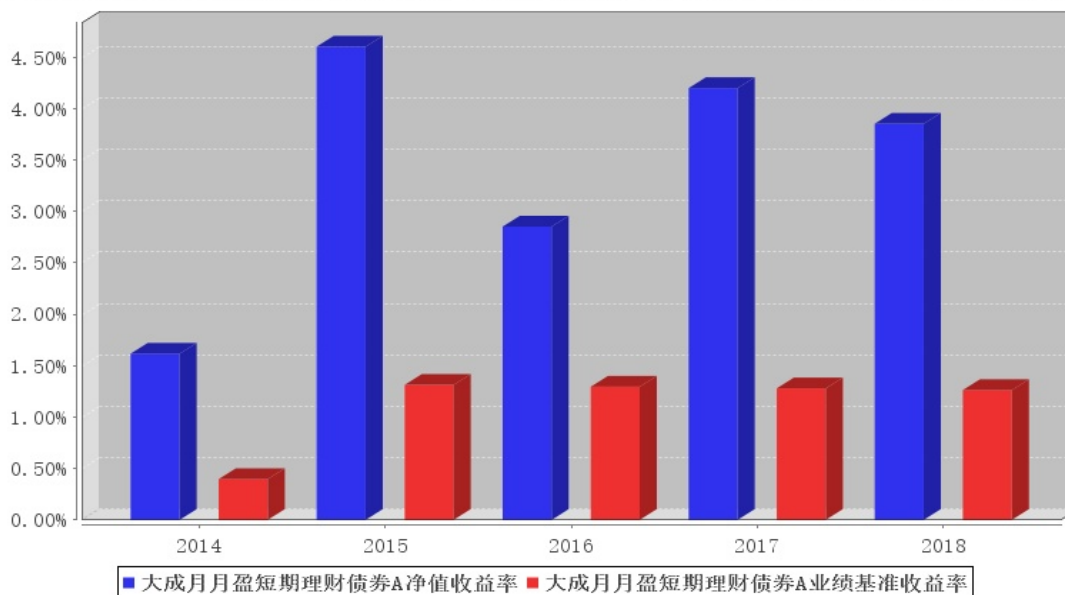


注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

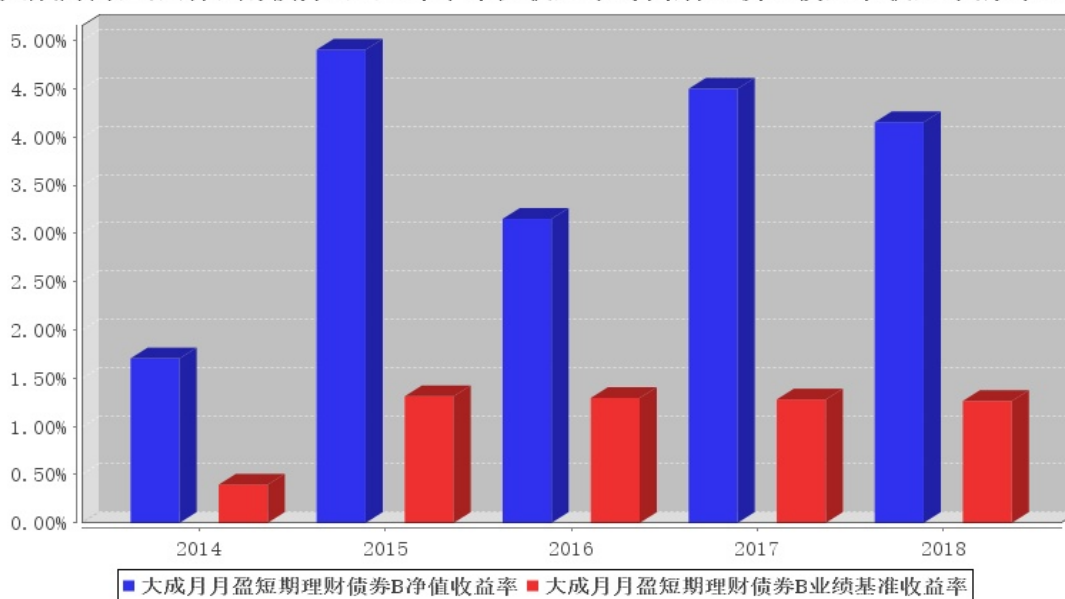


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

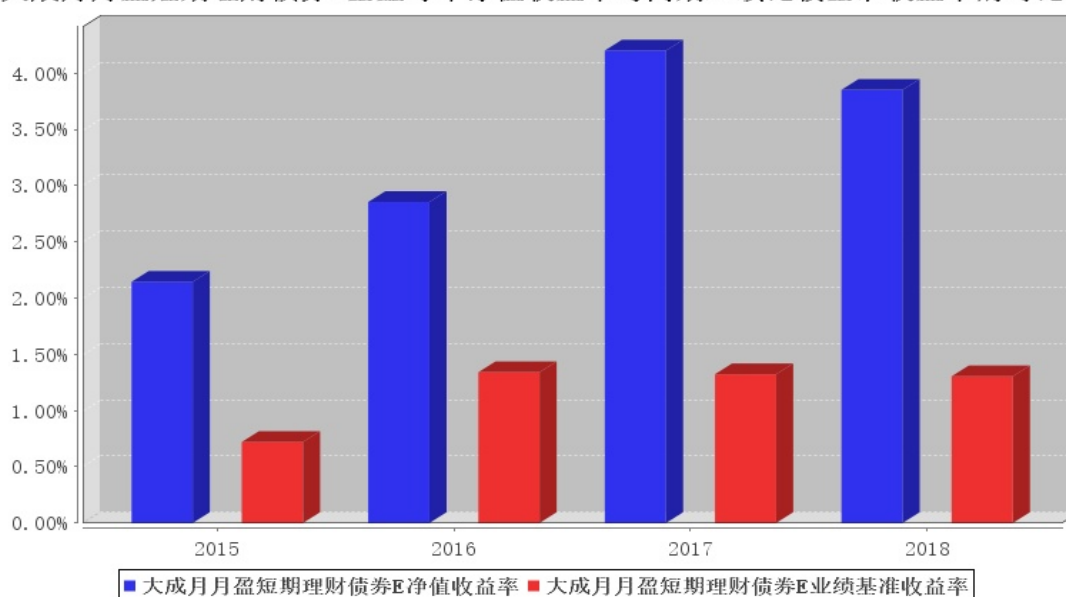
大成月月盈短期理财债券A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成月月盈短期理财债券B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成月月盈短期理财债券E基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金自 2014 年 9 月 12 日起由大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金转为大成月月盈短期理财债券证券投资基金,故本基金 2014 年基金净值收益率与业绩比较基准收益率的计算区间为 2014 年 9 月 12 日至 2014 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

#### 大成月月盈短期理财债券 A

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018 年	7,149,251.08	2,593,596.50	-142,447.81	9,600,399.77	-
2017 年	3,007,134.90	1,995,159.15	326,635.44	5,328,929.49	-
2016 年	973,146.74	197,176.11	-72,784.78	1,097,538.07	-
合计	11,129,532.72	4,792,481.04	111,402.85	16,033,416.61	-

#### 大成月月盈短期理财债券 B

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018 年	964,548,549.59	58,568,475.05	13,440,930.88	1,036,557,955.52	-
2017 年	253,371,376.31	68,623,847.86	19,106,170.80	341,101,394.97	-
2016 年	18,793,012.99	3,441,146.51	185,149.22	22,419,308.72	-
合计	1,236,712,938.89	130,626,920.14	32,732,250.90	1,400,072,109.93	-

#### 大成月月盈短期理财债券 E

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018 年	64,069,370.00	27,099,430.75	-4,711,714.18	86,457,086.57	-
2017 年	45,404,158.62	27,081,879.80	4,587,396.56	77,073,434.98	-
2016 年	426,202.96	636,081.86	174,588.88	1,236,873.70	-
合计	109,899,731.58	54,817,392.41	50,271.26	164,767,395.25	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为 2 亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 以及 QFLP 等资格。

历经二十年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。截至 2018 年 12 月 31 日，公司管理公募基金产品数量共 81 只。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈会荣	本基金基金经理	2018 年 3 月 14 日	-	11	经济学学士。 2004 年 7 月至 2007 年 10 月就职 于招商银行总行， 任资产托管部年金 小组组长。2007 年 10 月加入大成基金 管理有限公司，曾 担任基金运营部基 金助理会计师、基 金运营部登记清算 主管、固定收益总 部助理研究员、固 定收益总部基金经 理助理。2016 年 8 月 6 日起任大成 景穗灵活配置混合 型证券投资基金、 大成丰财宝货币市

					<p>场基金基金经理。</p> <p>2016 年 9 月 6 日起任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。</p> <p>2016 年 11 月 2 日起任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 3 月 1 日起任大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2017 年 3 月 22 日起任大成月添利理财债券型证券投资基金、大成慧成货币市场基金和大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月 14 日起任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金基金经理。</p> <p>2018 年 8 月 17 日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国</p>
李富强	本基金基金经理	2018 年 7 月 16 日	-	4	<p>经济学硕士。</p> <p>2009 年 7 月至 2013 年 12 月任中国银行间市场交易商协会市场创新部高级助理。2014 年 1 月至 2017 年 7 月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。</p> <p>2017 年 7 月加入大成基金管理有限公</p>

					<p>司，任职于固定收益总部。2018 年 7 月 16 日起任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成景利混合型证券投资基金、大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2018 年 11 月 16 日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> <p>具有基金从业资格。 国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研

究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 3 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年，在金融去杠杆、地方债务强约束的情况下，国内 M2 同比增速低位徘徊，社会融资存量规模同比增速不断下行。虽然央行逆周期调节并于 2018 年 4 月、6 月、10 月调低银行存款准备金率，并于 2018 年 3 月之后未跟随美国加息调高 SLF 利率，但由于风险偏好的下降和实体投资需求的减少，宽货币向宽信信用的传导并不通畅。经济方面，地方政府债务整顿引起基建投资趋势线下滑，房地产投资基本保持稳定，制造业投资保持增长，消费品零售总额累计同比下滑，受到中美贸易战抢进出口影响进出口累计同比增速先增后落。整体来讲 2018 年国内经济下行压力加大。受经济下滑、货币政策宽松的影响，银行间资金利率趋势性下行，货币市场工具到期收益率逐步下行，货币基金收益逐步走低。

组合操作上，本基金根据市场变化，选择月末、季末等资金利率高点加大仓位和久期配置，努力提高静态收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成月月盈短期理财债券 A 的基金份额净值收益率为 3.8917%，本报告期大成月月盈短期理财债券 B 的基金份额净值收益率为 4.1985%，本报告期大成月月盈短期理财债券 E 的基金份额净值收益率为 3.8661%，同期业绩基准收益率为 1.3500%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，货币政策将继续宽松，财政政策进一步发力。货币政策方面，在宽信用企稳之前，宽松的货币政策仍是必须的，为激励银行向市场贷款，未来定向降准、TMLF 等结构化工具仍有空间，预计资金面在未来一段时间内仍保持宽松。财政政策方面，主要体现在减税和补短板的新基建方面，但是积极的财政政策面临资金来源的压力，未来经济下行压力仍大。在宽松货币政策的呵护下，预计 2019 年资金面依旧保持较为宽松状态，货币基金和理财基金收益将保持稳定。

投资操作上，本基金将继续以保障流动性为根本，在关键时点适度加长配置期限并加大仓位配置，努力提高组合静态收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、社保基金及机构投资部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证

券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。据本基金基金合同中收益分配有关原则的规定：本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。本报告期内本基金应分配利润 1,132,615,441.86 元，报告期内已分配利润 1,132,615,441.86 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成月月盈短期理财债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。



## § 6 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计, 注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容, 应阅读年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

报告截止日: 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	15,666,630,915.80	12,873,378,864.33
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	10,452,058,179.42	9,217,296,625.89
其中: 股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	10,452,058,179.42	9,217,296,625.89
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	1,500,481,200.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	201,846,512.39	78,068,958.78
应收股利	-	-
应收申购款	29,754.04	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	26,320,565,361.65	23,669,225,649.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-

卖出回购金融资产款	3,418,681,871.96	5,972,093,691.98
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	5,858,946.69	3,319,635.76
应付托管费	1,735,984.17	983,595.77
应付销售服务费	290,463.71	838,673.58
应付交易费用	101,975.45	262,798.25
应交税费	292,926.30	-
应付利息	3,858,265.88	6,433,743.29
应付利润	33,225,076.35	24,638,307.46
递延所得税负债	-	-
其他负债	364,000.00	309,000.00
负债合计	3,464,409,510.51	6,008,879,446.09
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	22,856,155,851.14	17,660,346,202.91
未分配利润	-	-
所有者权益合计	22,856,155,851.14	17,660,346,202.91
负债和所有者权益总计	26,320,565,361.65	23,669,225,649.00

注： 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额净值 1.0000 元，大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金份额总额 22,856,155,851.14 份，其中 A 类基金份额总额 126,466,766.59 份，B 类基金份额总额 22,585,166,967.68 份，E 类基金份额总额 144,522,116.87 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	1,299,819,589.37	538,104,947.14
1. 利息收入	1,284,078,787.38	527,845,538.81
其中：存款利息收入	714,966,868.23	172,911,592.68
债券利息收入	510,625,759.27	267,442,758.58
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	58,486,159.88	87,491,187.55
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	15,740,801.99	10,259,408.33

其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	15,740,801.99	10,259,408.33
资产支持证券投资 收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	-	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	-	-
减：二、费用	167,204,147.51	114,601,187.70
1. 管理人报酬	76,511,109.17	26,020,758.49
2. 托管费	22,669,958.22	7,709,854.27
3. 销售服务费	9,682,678.13	6,618,359.00
4. 交易费用	766.65	3,383.47
5. 利息支出	57,472,800.03	73,716,511.62
其中：卖出回购金融资产 支出	57,472,800.03	73,716,511.62
6. 税金及附加	255,111.86	-
7. 其他费用	611,723.45	532,320.85
三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)	1,132,615,441.86	423,503,759.44
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“- ”号填列)	1,132,615,441.86	423,503,759.44

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：大成月月盈短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益(基金净值)	17,660,346,202.91	-	17,660,346,202.91
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期	-	1,132,615,441.86	1,132,615,441.86

利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	5,195,809,648.23	-	5,195,809,648.23
其中:1.基金申购款	32,447,420,216.80	-	32,447,420,216.80
2.基金赎回款	-27,251,610,568.57	-	-27,251,610,568.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,132,615,441.86	-1,132,615,441.86
五、期末所有者权益(基金净值)	22,856,155,851.14	-	22,856,155,851.14
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,285,808,927.78	-	1,285,808,927.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	423,503,759.44	423,503,759.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	16,374,537,275.13	-	16,374,537,275.13
其中:1.基金申购款	42,833,256,254.28	-	42,833,256,254.28
2.基金赎回款	-26,458,718,979.15	-	-26,458,718,979.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-423,503,759.44	-423,503,759.44

五、期末所有者 权益（基金净值）	17,660,346,202.91	-	17,660,346,202.91
---------------------	-------------------	---	-------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗登攀</u>	<u>周立新</u>	<u>刘亚林</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额

的适用比例计算缴纳。

### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	76,511,109.17	26,020,758.49
其中：支付销售机构的客户维护费	325,892.50	146,919.74

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.27% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.27% / 当年天数。

## 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,669,958.22	7,709,854.27

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.08% / 当年天数。

## 7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E	合计
大成基金	14,665.93	2,591,235.33	6,301,129.39	8,907,030.65
中国银行	53,334.50	497.78	1,943.38	55,775.66
合计	68,000.43	2,591,733.11	6,303,072.77	8,962,806.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E	合计
大成基金	7,524.09	766,948.13	5,469,530.35	6,244,002.57
中国银行	65,821.07	100.41	-	65,921.48
合计	73,345.16	767,048.54	5,469,530.35	6,309,924.05

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给大成基金，再由大成基金计算并支付给各基金销售机构。A 级基金份额、B 级基金份额和 E 级基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.30%、0.01% 和 0.30%。销售服务费的计算公式为：对应级别日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

## 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	320,098,838.35	88,354,872.69	-	-	-	-
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
光大证券	89,710,943.48	-	-	-	-	-
中国银行	495,058,141.16	578,972,824.82	-	-	-	-

## 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期	本期
	2018年01月01日至 2018年12月31日	2018年01月01日至 2018年12月31日	2018年01月01日至 2018年12月31日
	大成月月盈短期理财 债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财 债券 E
基金合同生效日（ 2014年9月12日） 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份 额	-	30,331,061.10	-
期间申购/买入总份 额	-	62,883,259.90	-
期间因拆分变动份 额	-	-	-
减：期间赎回/卖出 总份额	-	-	-
期末持有的基金份 额	-	93,214,321.00	-
期末持有的基金份 额	0.0000%	0.4078%	0.0000%



占基金总份额比例			
项目	上年度可比期间 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日
	大成月月盈短期理财 债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财 债券 E
基金合同生效日（ 2014 年 9 月 12 日） 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份 额	-	30,331,061.10	-
期间因拆分变动份 额	-	-	-
减：期间赎回/卖出 总份额	-	-	-
期末持有的基金份 额	-	30,331,061.10	-
期末持有的基金份 额 占基金总份额比例	0.0000%	0.1700%	0.0000%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,630,915.80	27,320.44	3,378,864.33	107,605.28

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

## 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
中国银行	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
中国银行	011759051	17 华电 SCP008	簿记建档集中 配售	1,000,000	100,000,000.00

## 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.5 期末(2018 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,418,681,871.96 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	-------	-------	--------

			价		
011801069	18 深能源 SCP006	2019-01-09	100.00	2,000,000	200,004,452.20
111810467	18 兴业银 行 CD467	2019-01-02	98.37	60,000	5,902,235.37
111810467	18 兴业银 行 CD467	2019-01-07	98.37	60,000	5,902,235.37
111812178	18 北京银 行 CD178	2019-01-03	98.57	1,000,000	98,568,983.99
111812187	18 北京银 行 CD187	2019-01-03	98.51	60,000	5,910,342.23
111812193	18 北京银 行 CD193	2019-01-03	98.40	1,000,000	98,397,519.55
111820166	18 广发银 行 CD166	2019-01-02	99.49	2,150,000	213,909,747.43
111871037	18 天津银 行 CD355	2019-01-04	98.50	2,000,000	196,997,382.68
111871644	18 盛京银 行 CD574	2019-01-02	98.45	3,000,000	295,359,077.04
111872061	18 江阴农 村商业银 行 CD110	2019-01-04	98.31	2,000,000	196,614,625.80
111872111	18 河北银 行 CD058	2019-01-02	98.37	1,020,000	100,342,322.01
111872296	18 广东华 兴银行 CD193	2019-01-10	98.30	1,850,000	181,850,587.95
111884387	18 长沙银 行 CD166	2019-01-03	98.54	1,090,000	107,403,949.17
111884712	18 江苏紫 金农商行 CD069	2019-01-04	99.32	1,100,000	109,250,538.13
111884730	18 台州银 行 CD051	2019-01-10	99.32	2,000,000	198,637,342.06
111884799	18 大连银 行 CD147	2019-01-04	99.36	1,070,000	106,310,506.66
111885402	18 张家口 银行 CD036	2019-01-07	99.25	1,000,000	99,250,248.31
111885507	18 江苏紫 金农商行 CD077	2019-01-15	99.23	1,020,000	101,214,747.85
140202	14 国开 02	2019-01-02	100.11	300,000	30,032,059.63
140219	14 国开 19	2019-01-09	101.13	500,000	50,565,450.91
140219	14 国开 19	2019-01-02	101.13	2,000,000	202,261,803.64

140408	14 农发 08	2019-01-02	100.37	800,000	80,297,118.24
160420	16 农发 20	2019-01-02	99.94	2,000,000	199,889,697.00
180209	18 国开 09	2019-01-07	100.25	30,000	3,007,462.57
180209	18 国开 09	2019-01-02	100.25	2,060,000	206,512,429.55
180407	18 农发 07	2019-01-02	100.38	600,000	60,225,481.24
180407	18 农发 07	2019-01-09	100.38	4,000,000	401,503,208.28
合计				35,770,000	3,556,121,554.86

#### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	10,452,058,179.42	39.71
	其中：债券	10,452,058,179.42	39.71
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购 的买入返售金融资 产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	15,666,630,915.80	59.52
4	其他各项资产	201,876,266.43	0.77
5	合计	26,320,565,361.65	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.32	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值 的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,418,681,871.96	14.96
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金

资产净值的 40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	126
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 150 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	4.91	14.96
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	1.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	49.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	55.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	114.27	14.96

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

无。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,235,297,198.61	5.40
	其中：政策性金融	1,235,297,198.61	5.40

	债		
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,740,047,179.32	7.61
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,476,713,801.49	32.71
8	其他	-	-
9	合计	10,452,058,179.42	45.73
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率 债券	-	-

### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产 净值比例 （%）
1	111820086	18 广发银行 CD086	5,000,000	494,006,411.12	2.16
2	180407	18 农发 07	4,600,000	461,728,689.53	2.02
3	011801792	18 中铁建 SCP001	3,000,000	300,011,204.83	1.31
4	111884870	18 天津银行 CD257	3,000,000	298,066,811.62	1.30
5	111885611	18 华融湘江银 行 CD167	3,000,000	297,846,670.53	1.30
6	111812184	18 北京银行 CD184	3,000,000	295,700,747.79	1.29
7	111871644	18 盛京银行 CD574	3,000,000	295,359,077.04	1.29
8	111872130	18 东莞农村商 业银行 CD132	3,000,000	295,124,405.98	1.29
9	111872797	18 福建海峡银 行 CD049	3,000,000	294,613,428.86	1.29
10	111885042	18 成都农商银 行 CD015	2,800,000	278,144,490.04	1.22

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1521%
报告期内偏离度的最低值	-0.0035%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0578%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

#### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资明细

无。

#### 8.9 投资组合报告附注

##### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币 1.0000 元。

##### 8.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

无。

##### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	201,846,512.39
4	应收申购款	29,754.04
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	201,876,266.43

##### 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份 额	持有 人 户 数	户均持有的基金 份 额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
大成月月盈短期理财债券 A	8,689	14,554.81	37,947.99	0.03	126,428,818.60	99.97
大成月月盈短期理财债券 B	30	752,838,898.92	22,585,166,967.68	100.00	0.00	0.00
大成月月盈短期理财债券 E	9,894	14,607.05	0.00	0.00	144,522,116.87	100.00
合计	18,613	1,227,967.33	22,585,204,915.67	98.81	270,950,935.47	1.19

注:1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对分级份额,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。



2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

无。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成月月盈短期理财债券 A	318,368.15	0.2517
	大成月月盈短期理财债券 B	-	0.0000
	大成月月盈短期理财债券 E	10,369.66	0.0072
	合计	328,737.81	0.0014

注：下属分级基金份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用各分级基金份额的合计数。

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	大成月月盈短期理财债券 A	0
	大成月月盈短期理财债券 B	0
	大成月月盈短期理财债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	大成月月盈短期理财债券 A	0
	大成月月盈短期理财债券 B	0
	大成月月盈短期理财债券 E	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成月月盈短期理财债券 A	大成月月盈短期理财债券 B	大成月月盈短期理财债券 E
基金合同生效日（2014 年 9 月 12 日）基金份额总额	35,756,883.12	145,202,557.59	-
本报告期期初基金份额总额	180,497,323.31	14,889,242,261.93	2,590,606,617.67

本报告期基金总申购份额	818,523,588.67	25,980,026,506.08	5,648,870,122.05
减：本报告期基金总赎回份额	872,554,145.39	18,284,101,800.33	8,094,954,622.85
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	126,466,766.59	22,585,166,967.68	144,522,116.87

注：本基金合同生效日为 2014 年 9 月 12 日，于 2015 年 6 月 19 日起增加 E 类份额。红利再投资作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，不单独列示。

依据《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金招募说明书》规定，本基金分设 A 类、B 类和 E 类基金份额。若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额。若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。因申购、赎回、基金转换等交易，本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额之间可以发生基金份额自动升级或者降级，而 E 类基金份额不可以与其他两类基金份额发生升级或降级。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的重大人事变动

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，本年度应支付的审计费用为 15.5 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

注:1. 本报告期内本基金退租交易单元:渤海证券、中投证券;新增交易单元:无。

2. 根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:

- (一) 财务状况良好,最近一年无重大违规行为;
- (二) 经营行为规范,内控制度健全,能满足各投资组合运作的保密性要求;
- (三) 研究实力较强,能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务;
- (四) 具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,有足够的交易和清算能力,满足各投资组合证券交易需要;
- (五) 能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务;
- (六) 相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下:

本报告期内增加交易单元:太平洋证券、长江证券;

本报告期内退租交易单元:无。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投 资	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情 况
--------	----------------	----------------

者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20180108-20180109	3,500,000,000.00	69,298,812.65	3,569,298,812.65	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同的有关条款进行了修改，主要在前言、释义、投资交易限制、申购与赎回管理、基金估值管理、信息披露等方面对流动性风险管控措施进行明确，具体内容详见 2018 年 3 月 27 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

大成基金管理有限公司

2019 年 03 月 29 日

